

CORRECTIONS A :
 DECOMPOSITION DE MARTINGALES LOCALES
 ET RAREFACTION DES SAUTS.

Rolando REBOLLEDO.

Nous avons relevé certaines inexactitudes dans l'article

[1] paru au Seminaire de Probabilités n° XIII :

1. Lemme 2, page 140, partie 1), Il est dit que \underline{M}^ϵ et \overline{M}^ϵ sont orthogonales, ce qui est faux si M n'est pas quasi-continue à gauche.

Cependant, la relation de domination (1) est juste.

Par ailleurs, la relation de domination (4) doit être remplacée par

$$(4) \quad \langle \underline{M}^\epsilon; \overline{M}^\epsilon \rangle^* \leq \langle [\underline{M}^\epsilon, \overline{M}^\epsilon] \rangle^* \leq 4\epsilon \tilde{\alpha}(M) \quad (\text{c.f. [2], I.1.3})$$

2. La condition de raréfaction asymptotique des sauts ⁽¹⁾ (page 143)

doit être remplacée par

$$(1) \quad \langle \overline{M}_n^\epsilon, \overline{M}_n^\epsilon \rangle(t) + \langle [\overline{M}_n^\epsilon, \overline{M}_n^\epsilon] \rangle^*(t) \xrightarrow[n \uparrow 0]{\mathbb{P}} 0 \quad \text{pour tout } t \in \mathbb{R}_+, \text{ tout } \epsilon > 0.$$

Avec cette modification, le lemme 5 reste vrai. (C.f. [2], II.3.15)

[1] REBOLLEDO, R. Décomposition de Martingales locales et Raréfaction des sauts. Sem. de Proba. XIII, Lect. Notes in Maths. 721 (1978), 138-146.

[2] REBOLLEDO, R. La Méthode de Martingales appliquée à l'étude de la convergence en Loi de Processus. Rapport U. de Reims (1978), à paraître aux Mémoires de la S.M.F.

Faculté des Sciences
 Département de Mathématiques
 Parc Valrose

06034 - NICE CEDEX